

大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型
发起式基金中基金（FOF）
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 41 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 41 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 42 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 42 |

| | |
|--|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 42 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 42 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 42 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 42 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 50 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 51 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 51 |
| § 10 重大事件揭示 | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 52 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 52 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 52 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 52 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 52 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.9 其他重大事件 | 54 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| § 12 备查文件目录 | 56 |
| 12.1 备查文件目录 | 56 |
| 12.2 存放地点 | 56 |
| 12.3 查阅方式 | 56 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------|
| 基金名称 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF） | |
| 基金简称 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF） | |
| 基金主代码 | 016197 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 8 月 30 日 | |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 52,356,526.81 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码 | 016197 | 019795 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 51,899,653.38 份 | 456,873.43 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，本基金运用动态资产配置策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳定回报。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%+中债综合指数收益率*75% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，目标风险系列 FOF 产品中，风险系列根据不同风险程度划分为三档，分别是稳健、均衡、积极。本基金以风险控制为产品主要导向，定位为较为稳健的 FOF 产品。本基金相对股票型基金、股票型基金中基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|----------------------|--------------------------|
| 名称 | | 大成基金管理有限公司 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 段皓静 | 张立学 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn | zhanglixue@psbcoa.com.cn |

| | | |
|--------|--|-----------------------|
| 客户服务电话 | 4008885558 | 95580 |
| 传真 | 0755-83199588 | 010-68858120 |
| 注册地址 | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 | 北京市西城区金融大街 3 号 |
| 办公地址 | 广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座 |
| 邮政编码 | 518054 | 100808 |
| 法定代表人 | 吴庆斌 | 刘建军 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|---|
| 注册登记机构 | 大成基金管理有限公司 | 广东省深圳市南山区海德三 道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数 据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|---------------------------------|
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合 发起式 (FOF) A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合 发起式 (FOF) Y |
| 本期已实现收益 | -284,201.95 | 2,577.26 |
| 本期利润 | 1,073,231.54 | 328.61 |
| 加权平均基金份 额本期利润 | 0.0212 | 0.0017 |
| 本期加权平均净 值利润率 | 2.20% | 0.17% |
| 本期基金份额净 值增长率 | 2.10% | 3.05% |
| 3.1.2 期末数 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |

| 据和指标 | | |
|--------------|------------------|------------|
| 期末可供分配利润 | -2,149,216.45 | -18,096.13 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0414 | -0.0396 |
| 期末基金资产净值 | 50,659,227.46 | 446,757.25 |
| 期末基金份额净值 | 0.9761 | 0.9779 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -2.39% | 3.05% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -0.52% | 0.18% | -0.45% | 0.13% | -0.07% | 0.05% |
| 过去三个月 | 1.01% | 0.19% | 0.56% | 0.18% | 0.45% | 0.01% |
| 过去六个月 | 2.10% | 0.21% | 1.84% | 0.24% | 0.26% | -0.03% |
| 过去一年 | -1.77% | 0.22% | -0.24% | 0.23% | -1.53% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.39% | 0.20% | -0.88% | 0.24% | -1.51% | -0.04% |

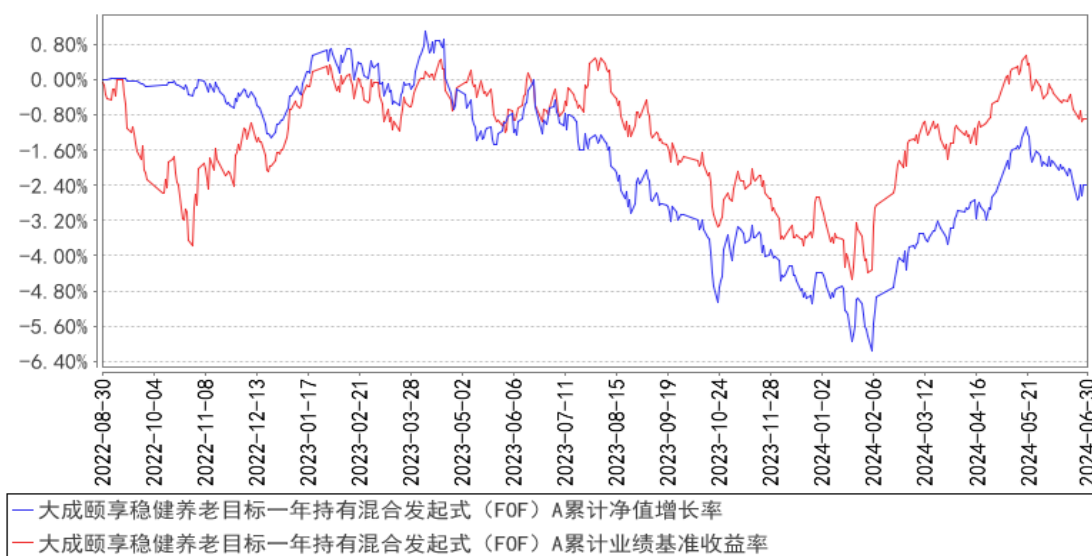
大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

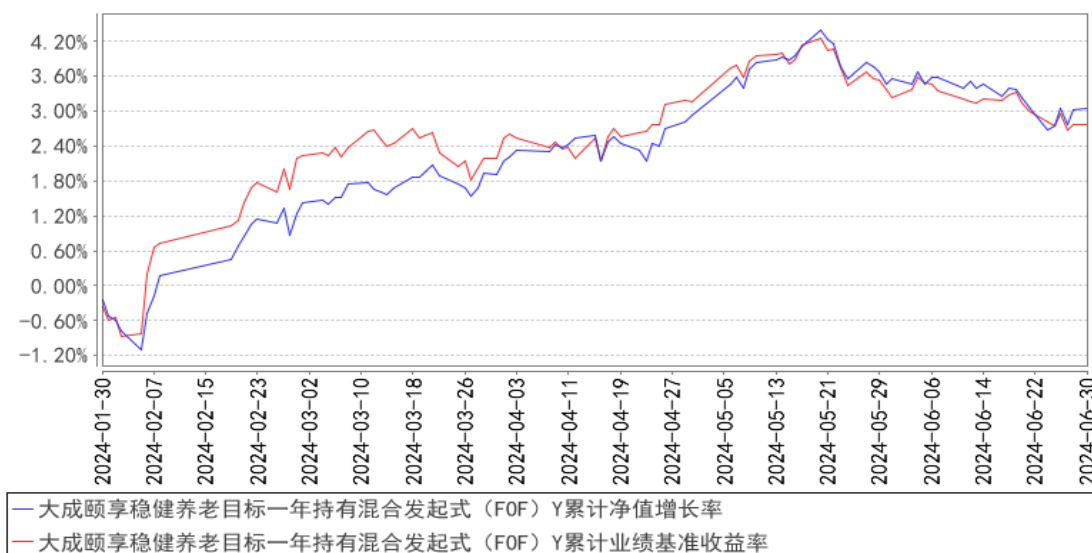
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | -0.49% | 0.18% | -0.45% | 0.13% | -0.04% | 0.05% |
| 过去三个月 | 1.11% | 0.19% | 0.56% | 0.18% | 0.55% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.05% | 0.20% | 2.77% | 0.23% | 0.28% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金自 2023 年 10 月 23 日起增设 Y 类基金份额类别。Y 类的净值增长率和业绩比较基

准收益率自 2024 年 1 月 30 日有份额之日开始计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈志伟 | 本基金基金经理 | 2023 年 8 月 4 日 | - | 8 年 | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。2011 年 7 月至 2014 年 2 月任华润深国投信托有限公司证券投资部经理。2014 年 2 月至 2016 年 6 月任方正东亚信托有限公司对冲基金部总监。2016 年 6 月至 2020 年 4 月任鹏华资产管理有限公司投资管理部高级研究员。2020 年 5 月至 2023 年 6 月任生命保险资产管理有限公司组合管理部投资经理。2023 年 6 月加入大成基金管理有限公司，现任大类资产配置部基金经理。2023 年 8 月 4 日起任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2024 年 3 月 14 日起任大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、大成颐禧积极养老目 |

| | | | | | |
|----|----------------------------|--------------------|--------------------|------|--|
| | | | | | 标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。具有基金从业资格。 国籍：中国 |
| 吴翰 | 本基金基金经理， 大类资产配置部副 总监 | 2022 年 8 月 30 日 | 2024 年 5 月 15 日 | 24 年 | 浙江大学管理学博士。2000 年 12 月至 2002 年 6 月任广东证券股份有限公司（现安信证券）研究发展中心高级研究员。2002 年 6 月至 2010 年 7 月历任国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部高级经理、主管。2010 年 7 月至 2014 年 8 月先后担任大成基金管理有限公司产品研发与金融工程部首席产品设计师、副总监。2014 年 9 月至 2015 年 4 月任上海源实资产管理有限公司助理总经理。2015 年 4 月至 2017 年 3 月先后担任大成基金管理有限公司产品研发与金融工程部副总监、数量与指数投资部副总监。2017 年 3 月至 2021 年 9 月历任国投瑞银基金管理有限公司专户投资部投资经理、资产配置部基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 5 月就职于大成基金管理有限公司，曾担任大类资产配置部副总监。2022 年 8 月 2 日至 2024 年 5 月 15 日任大成丰华稳健六个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2022 年 8 月 30 日至 2024 年 5 月 15 日任大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2023 年 2 月 13 日至 2024 年 5 月 15 日任大成养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。2023 年 4 月 19 日至 2023 年 7 月 14 日任大成兴享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。2023 年 6 月 29 日至 2024 年 5 月 15 日任大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。具有基金从业资格。 国籍：中国 |

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情形。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济运行稳定，不过政策预期变化较大。上半年国内 GDP 实现 5% 的增速，运行平稳，其中生产、制造业投资及出口表现较好，上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6%，制造业投资增长 9.5%，出口增长 6.9%。CPI 温和回升，PPI 降幅收窄。政策层面较为积极，4 月份新“国九条”的发布也给资本市场带来了新的变化和机遇。从长期看，新“国九条”的落实有利于提升上市公司质量，有利于建设“以投资者为本”的资本市场，提升了国内资本市场的投资价值。海外方面，虽然宏观经济有所波动，但总体平稳，上半年全球 PMI 指数维持在 53 左右的水平。加拿大央行、欧洲央行于 6 月份开启降息，也标志着主要发达经济体央行结束加息周期，进入降息周期。美国经济的韧性更强，美联储进入宽松周期的节奏更靠后，但预计年底也将开启降息。

从资产表现上来看，上半年国内权益波动较大，指数层面整体表现稳定，沪深 300 指数上涨

0.89%，不过市场风格分化较大，全 A 等权指数则下跌 21%。国内债市表现较强，10 年国债收益率延续下行趋势。海外市场上涨，纳斯达克指数及日经 225 指数均上涨超过 18%，欧洲股市表现稍弱，但总体上涨。商品表现较好，但二季度后波动加大，黄金、铜等有色品种 4 月份大涨后回落，原油价格宽幅震荡。

具体到本基金的投资运作上，报告期内根据市场变化国内权益仓位有所增减，总体维持在基准水平附近，结构上以价值风格为主，二季度小幅增加了港股的配置。商品的仓位小幅波动，整体变化不大。减持了转债资产的仓位，主要是因为部分转债上市公司的信用风险暴露，转债的投资逻辑发生变化，投资难度增加。在海外资产上，维持了海外权益资产的仓位基本不变，结构上做了小幅调整，小幅增加了 QDII 债基的配置。从效果上来看，由于高波动资产仓位提升，产品的波动率有所提升。

本基金定位为稳健类风格，通过多资产多策略的配置实现较低回撤、适中收益的目标。本基金按照积极型资产配置策略，识别并适应市场环境的变化，保持战略资产配置的基本稳定，并根据市场变化战术性调整组合结构，在同等风险情况下选择预期收益较高的资产类别，在同等预期收益的情况下选择风险较低的资产类别，并通过选取优质基金产品表达配置观点。本基金属于养老型产品，目标是要帮助投资者实现养老需求，这需要在一定时间尺度内战胜通胀，实现稳定增值。本基金将致力于发挥资产配置的优势，以更广阔的视野寻找相关度低、预期收益较好的资产及策略进行组合配置。后续基金管理人将继续深化在大类资产和策略上的研究，争取为投资人实现绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A 的基金份额净值为 0.9761 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.84%；截至本报告期末大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y 的基金份额净值为 0.9779 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，随着美联储开启降息周期，海外流动性将继续改善。国内随着政策落地，经济进入补库存阶段，经济基本面延续改善。长期来看，综合政治、经济、意识形态等大周期因素，未来世界将面临诸多不确定性，给传统投资带来挑战。此时我们不仅要关注微观，关注宏观，还要从史观的角度来思考问题。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估

值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证

券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 417,633.04 | 480,633.21 |
| 结算备付金 | | 31,202.21 | 167,446.84 |
| 存出保证金 | | 11,507.79 | 27,620.67 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 42,332,834.39 | 43,049,184.61 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 38,265,604.07 | 36,441,411.54 |
| 债券投资 | | 4,067,230.32 | 6,607,773.07 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | 700,553.75 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 1,135,200.00 | 254,115.11 |
| 应收股利 | | 0.06 | 3,566.00 |
| 应收申购款 | | 7,501,190.73 | 7,598,920.06 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | 1,471.55 | 1,281.23 |
| 资产总计 | | 51,431,039.77 | 52,283,321.48 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 162,679.61 |
| 应付赎回款 | | 259,167.67 | 398,347.22 |
| 应付管理人报酬 | | 18,308.76 | 20,369.22 |
| 应付托管费 | | 7,692.18 | 7,697.80 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 104.89 | 115.66 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 39,781.56 | 130,000.00 |
| 负债合计 | | 325,055.06 | 719,209.51 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 52,356,526.81 | 53,936,309.46 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -1,250,542.10 | -2,372,197.49 |
| 净资产合计 | | 51,105,984.71 | 51,564,111.97 |
| 负债和净资产总计 | | 51,431,039.77 | 52,283,321.48 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 52,356,526.81 份，其中大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A 基金份额总额为 51,899,653.38 份，基金份额净值 0.9761 元。大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y 基金份额总额为 456,873.43 份，基金份额净值 0.9779 元。

6.2 利润表

会计主体：大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|
|-----|-----|----|---------|

| | | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 1,281,507.73 | 462,727.91 |
| 1. 利息收入 | | 6,093.11 | 17,358.01 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 4,785.11 | 17,358.01 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,308.00 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -87,230.20 | -221,110.88 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | 112,767.17 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -344,584.26 | -612,758.39 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 180,156.72 | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 77,197.34 | 278,880.34 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 1,355,184.84 | 662,531.73 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 7,459.98 | 3,949.05 |
| 减：二、营业总支出 | | 207,947.58 | 289,498.29 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 118,926.46 | 166,887.74 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 48,729.41 | 57,841.51 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.24 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 510.15 | 302.27 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.25 | 39,781.56 | 64,466.77 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,073,560.15 | 173,229.62 |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|--|--------------|------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,073,560.15 | 173,229.62 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,073,560.15 | 173,229.62 |

6.3 净资产变动表

会计主体：大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 53,936,309.46 | - | -2,372,197.49 | 51,564,111.97 |
| 二、本期期初净资产 | 53,936,309.46 | - | -2,372,197.49 | 51,564,111.97 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -1,579,782.65 | - | 1,121,655.39 | -458,127.26 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,073,560.15 | 1,073,560.15 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -1,579,782.65 | - | 48,095.24 | -1,531,687.41 |
| 其中：1. 基金申购款 | 11,786,076.41 | - | -349,819.25 | 11,436,257.16 |
| 2. 基金赎回款 | -13,365,859.06 | - | 397,914.49 | -12,967,944.57 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 52,356,526.81 | - | -1,250,542.10 | 51,105,984.71 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 58,421,556.09 | - | -541,837.85 | 57,879,718.24 |

| | | | | |
|--|---------------|---|-------------|---------------|
| 二、本期期初净资产 | 58,421,556.09 | - | -541,837.85 | 57,879,718.24 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 12,163.46 | - | 173,180.52 | 185,343.98 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 173,229.62 | 173,229.62 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | 12,163.46 | - | -49.10 | 12,114.36 |
| 其中：1. 基金申购款 | 12,163.46 | - | -49.10 | 12,114.36 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 58,433,719.55 | - | -368,657.33 | 58,065,062.22 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

范瑛

梁靖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1388号《关于准予大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》注册,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 58,416,680.91 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普

通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0736 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2022 年 8 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 58,421,506.29 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,825.38 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,138.90 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金设置投资者最短持有期限(即锁定期)为一年。对于每份基金份额,自基金合同生效日(含)(对认购份额而言,下同)或基金份额申购申请确认日(含)(对申购份额而言,下同)起至次年的年度对日的前一日(含该日)为最短持有期限。在最短持有期限内基金份额持有人不能就该份额提出赎回申请。每份基金份额的最短持有期限结束日的下一个工作日(含)起,基金份额持有人可就该份额提出赎回申请。因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的最短持有期限。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 10 月 20 日发布的《关于大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)增设 Y 类基金份额并相应修订基金合同和托管协议的公告》,自 2023 年 10 月 23 日起对本基金进行份额分类,增加 Y 类份额,原有基金份额转为 A 类份额。其中,在投资人申购时收取前端申购费用的基金份额称为 A 类基金份额。根据《个人养老金投资公募基金业务管理暂行规定》针对个人养老金投资基金业务设立的基金份额类别称为 Y 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额分别设置基金代码并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募 REITs”)、QDII 基金、香港互认基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等)、股票(包括主板、创业板以及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票(简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额,包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

本基金的投资组合中，本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 25%，其中，上述权益类资产向上、向下的调整幅度最高分别为 5%及 10%，即权益类资产占基金资产的比例为 15%-30%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%。同时，股票、股票型基金、计入权益资产的混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 30%，投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*75%+中证 800 指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人 大成基金管理有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 417,633.04 |
| 等于：本金 | 417,471.74 |
| 加：应计利息 | 161.30 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 417,633.04 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|-----------|--------------|----------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 交易所市 | 4,052,585.37 | 13,440.32 | 4,067,230.32 | 1,204.63 |

| | | | | | |
|--------|-------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | 场 | | | | |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 4,052,585.37 | 13,440.32 | 4,067,230.32 | 1,204.63 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | 37,301,222.79 | - | 38,265,604.07 | 964,381.28 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 41,353,808.16 | 13,440.32 | 42,332,834.39 | 965,585.91 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 1,471.55 |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 1,471.55 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 39,781.56 |
| 合计 | 39,781.56 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 53,936,309.46 | 53,936,309.46 |
| 本期申购 | 11,329,202.98 | 11,329,202.98 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -13,365,859.06 | -13,365,859.06 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 51,899,653.38 | 51,899,653.38 |

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 456,873.43 | 456,873.43 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 456,873.43 | 456,873.43 |

注：申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | -1,952,023.41 | -420,174.08 | -2,372,197.49 |
| 本期期初 | -1,952,023.41 | -420,174.08 | -2,372,197.49 |
| 本期利润 | -284,201.95 | 1,357,433.49 | 1,073,231.54 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 87,008.91 | -28,468.88 | 58,540.03 |
| 其中：基金申购款 | -493,043.15 | 153,668.69 | -339,374.46 |
| 基金赎回款 | 580,052.06 | -182,137.57 | 397,914.49 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,149,216.45 | 908,790.53 | -1,240,425.92 |

大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------|-----------|------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 2,577.26 | -2,248.65 | 328.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -20,673.39 | 10,228.60 | -10,444.79 |
| 其中：基金申购款 | -20,673.39 | 10,228.60 | -10,444.79 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -18,096.13 | 7,979.95 | -10,116.18 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 4,081.81 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 520.23 |
| 其他 | 183.07 |
| 合计 | 4,785.11 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 43,017,198.50 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 43,349,191.16 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 3,704.39 |
| 减：交易费用 | 8,887.21 |
| 基金投资收益 | -344,584.26 |

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 42,132.99 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 138,023.73 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 180,156.72 |

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 15,060,437.84 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 14,824,665.34 |
| 减：应计利息总额 | 96,877.37 |
| 减：交易费用 | 871.40 |
| 买卖债券差价收入 | 138,023.73 |

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | - |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 77,197.34 |
| 合计 | 77,197.34 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 1,355,184.84 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 15,241.49 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | 1,339,943.35 |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 1,355,184.84 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | - |
| 销售服务费返还 | 7,459.98 |
| 合计 | 7,459.98 |

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------|---------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 27,191.77 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 122,348.91 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 27,277.09 |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 14,918.54 |
| 信息披露费 | 24,863.02 |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 39,781.56 |

6.4.7.26 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|---------------------|
| 大成基金管理有限公司(“大成基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮政储蓄银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日 |
|----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 118,926.46 | 166,887.74 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 40,770.28 | 71,687.46 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 78,156.18 | 95,200.28 |

注：本基金投资于基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人管理的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A类基金份额和Y类基金份额约定的管理费年费率分别为0.60%和0.30%。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日A/Y类基金份额的基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×约定年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023 |
|----|------------------------|---------------------------|
| | | |

| | 月 30 日 | 年 6 月 30 日 |
|----------------|-----------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 48,729.41 | 57,841.51 |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日 A 类基金份额和 Y 类基金份额的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额和 Y 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.20% 和 0.10%。其计算公式为：

日托管费 = 前一日 A/Y 类基金份额的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 本期 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 基金合同生效日（2022 年 8 月 30 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 12,671,070.84 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 11,505,145.93 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |

| | | |
|----------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 报告期末持有的基金份额 | 24,176,216.77 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 46.18% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 - |
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 基金合同生效日（2022年8月30日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,138.90 | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,138.90 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 17.11% | - |

注：基金管理人大成基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|--------|----------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 邮政储蓄银行 | 417,633.04 | 4,081.81 | 4,502,611.68 | 16,989.47 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

报告期末，本基金持有基金管理人大成基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 9,519,111.41 元，占本基金资产净值的比例为 18.63%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------|--|---|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | 589.00 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 8,313.41 | 3,942.13 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 34,963.03 | 11,331.40 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 6,062.60 | 1,858.63 |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | 113.07 | - |
| 当期交易基金产生的转换费（元） | 83.66 | - |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险的基础上，运用动态资产配置策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 4.03%（上年度末：8.33%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可

通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|--------------|--------------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 417,633.04 | - | - | - | 417,633.04 |
| 结算备付金 | 31,202.21 | - | - | - | 31,202.21 |
| 存出保证金 | 11,507.79 | - | - | - | 11,507.79 |
| 交易性金融资产 | 2,006,837.26 | 2,060,393.06 | - | 38,265,604.07 | 42,332,834.39 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.06 | 0.06 |
| 应收申购款 | 7,499,000.00 | - | - | 2,190.73 | 7,501,190.73 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,135,200.00 | 1,135,200.00 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,471.55 | 1,471.55 |
| 资产总计 | 9,966,180.30 | 2,060,393.06 | - | 39,404,466.41 | 51,431,039.77 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 259,167.67 | 259,167.67 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 18,308.76 | 18,308.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,692.18 | 7,692.18 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|--------------|------------|---------------|---------------|
| 应交税费 | - | - | - | 104.89 | 104.89 |
| 其他负债 | - | - | - | 39,781.56 | 39,781.56 |
| 负债总计 | - | - | - | 325,055.06 | 325,055.06 |
| 利率敏感度缺口 | 9,966,180.30 | 2,060,393.06 | - | 39,079,411.35 | 51,105,984.71 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 480,633.21 | - | - | - | 480,633.21 |
| 结算备付金 | 167,446.84 | - | - | - | 167,446.84 |
| 存出保证金 | 27,620.67 | - | - | - | 27,620.67 |
| 交易性金融资产 | 2,312,035.62 | 4,124,417.46 | 171,319.99 | 36,441,411.54 | 43,049,184.61 |
| 买入返售金融资产 | 700,553.75 | - | - | - | 700,553.75 |
| 应收股利 | - | - | - | 3,566.00 | 3,566.00 |
| 应收申购款 | 7,499,000.00 | - | - | 99,920.06 | 7,598,920.06 |
| 应收清算款 | - | - | - | 254,115.11 | 254,115.11 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,281.23 | 1,281.23 |
| 资产总计 | 11,187,290.09 | 4,124,417.46 | 171,319.99 | 36,800,293.94 | 52,283,321.48 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 398,347.22 | 398,347.22 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 20,369.22 | 20,369.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,697.80 | 7,697.80 |
| 应付清算款 | - | - | - | 162,679.61 | 162,679.61 |
| 应交税费 | - | - | - | 115.66 | 115.66 |
| 其他负债 | - | - | - | 130,000.00 | 130,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 719,209.51 | 719,209.51 |
| 利率敏感度缺口 | 11,187,290.09 | 4,124,417.46 | 171,319.99 | 36,081,084.43 | 51,564,111.97 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 7.96%（上年度末：12.81%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风

险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，将结合内外部的投资研究经验，分析各大类资产历史投资回报并对未来表现进行预判，拟定基金在各类资产的配置中枢。在战术资产配置层面，基金管理人将结合当期宏观经济、政策导向和市场趋势变等因素，对各大类资产的短期风险收益水平进行估算，动态分配符合风险目标的权重，使得不同环境中表现良好的各类资产都能够为投资组合提供预期收益贡献。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 25%，其中，上述权益类资产向上、向下的调整幅度最高分别为 5%及 10%，即权益类资产占基金资产的比例为 15%-30%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%。同时，股票、股票型基金、计入权益资产的混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 30%，投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过基金资产的 10%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|--------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | 38,265,604.07 | 74.87 | 36,441,411.54 | 70.67 |

| | | | | |
|---------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 38,265,604.07 | 74.87 | 36,441,411.54 | 70.67 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升5% | 1,809,255.62 | 2,152,227.07 |
| | 业绩比较基准下降5% | -1,809,255.62 | -2,152,227.07 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 40,325,997.13 | 40,737,148.99 |
| 第二层次 | 2,006,837.26 | 2,312,035.62 |
| 第三层次 | - | - |

| | | |
|----|---------------|---------------|
| 合计 | 42,332,834.39 | 43,049,184.61 |
|----|---------------|---------------|

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 38,265,604.07 | 74.40 |
| 3 | 固定收益投资 | 4,067,230.32 | 7.91 |
| | 其中：债券 | 4,067,230.32 | 7.91 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 448,835.25 | 0.87 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,649,370.13 | 16.82 |

| | | | |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 51,431,039.77 | 100.00 |
|---|----|---------------|--------|

注：截至报告期末，本基金因规模变动导致基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例被动低于基金资产的 80%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,006,837.26 | 3.93 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,060,393.06 | 4.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,067,230.32 | 7.96 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代 | 债券名称 | 数量 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 |
|----|-----|------|----|------|-----------|
|----|-----|------|----|------|-----------|

| | 码 | | (张) | | (%) |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|
| 1 | 019740 | 24 国债 09 | 20,000 | 2,006,837.26 | 3.93 |
| 2 | 110076 | 华海转债 | 1,500 | 162,903.49 | 0.32 |
| 3 | 118034 | 晶能转债 | 1,500 | 146,434.68 | 0.29 |
| 4 | 127041 | 弘亚转债 | 1,000 | 115,205.89 | 0.23 |
| 5 | 110082 | 宏发转债 | 1,000 | 111,719.18 | 0.22 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金属于稳健型的基金中基金，将根据基金合同约定的权益类、非权益类资产的目标配置比重进行资产配置。同时，基金经理将根据市场实际表现及预期判断，在基金合同约定的范围内对各大类资产配置比例进行动态调整。在严格控制风险的前提下，本基金运用动态资产配置策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，所投资的子基金整体运作情况良好。本基金的投资符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管 |
|----|------|------|------|---------|---------|--------------|--------------------|
|----|------|------|------|---------|---------|--------------|--------------------|

| | | | | | | | 理的基金 |
|----|--------|--------------------|--------|--------------|--------------|------|------|
| 1 | 002086 | 大成景安短融债券E | 契约型开放式 | 2,802,172.80 | 3,662,720.07 | 7.17 | 是 |
| 2 | 003280 | 鹏华丰恒债券 | 契约型开放式 | 2,218,080.69 | 2,457,189.79 | 4.81 | 否 |
| 3 | 007014 | 嘉合磐泰短债债券A | 契约型开放式 | 2,139,959.80 | 2,391,619.07 | 4.68 | 否 |
| 4 | 006947 | 华宝中短债债券A | 契约型开放式 | 1,921,375.33 | 2,251,467.61 | 4.41 | 否 |
| 5 | 008846 | 大成民稳增长混合A | 契约型开放式 | 1,817,014.47 | 2,195,680.29 | 4.30 | 是 |
| 6 | 008383 | 招商安心收益债券A | 契约型开放式 | 1,079,123.58 | 2,046,773.69 | 4.00 | 否 |
| 7 | 007360 | 易方达中短期美元债债券(QDII)A | 契约型开放式 | 1,636,042.78 | 1,842,511.38 | 3.61 | 否 |
| 8 | 007361 | 易方达中短期美元债债券(QDII)C | 契约型开放式 | 1,658,296.75 | 1,840,046.07 | 3.60 | 否 |
| 9 | 011658 | 汇添富中高等级信用债债券A | 契约型开放式 | 1,572,096.19 | 1,756,660.28 | 3.44 | 否 |
| 10 | 005754 | 平安短债债券A | 契约型开放式 | 1,311,981.82 | 1,588,941.18 | 3.11 | 否 |
| 11 | 110036 | 易方达双债增强债 | 契约型开 | 832,990.40 | 1,396,091.91 | 2.73 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------|---------------|--------------|--------------|------|---|
| | | 券 C | 放式 | | | | |
| 12 | 040022 | 华安可转债债券 A | 契约型开放式 | 663,372.98 | 1,168,863.19 | 2.29 | 否 |
| 13 | 513100 | 国泰纳斯达克100(QDII-ETF) | 交易型开放式(ETF) | 700,000.00 | 1,032,500.00 | 2.02 | 否 |
| 14 | 560070 | 汇添富中证国新央企股东回报 ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,000,000.00 | 1,003,000.00 | 1.96 | 否 |
| 15 | 518880 | 华安黄金易(ETF) | 交易型开放式(ETF) | 170,000.00 | 900,490.00 | 1.76 | 否 |
| 16 | 019449 | 摩根日本精选股票(QDII)C | 上市契约型开放式(LOF) | 500,727.57 | 805,470.37 | 1.58 | 否 |
| 17 | 515100 | 景顺长城中证红利低波动100ETF | 交易型开放式(ETF) | 590,000.00 | 783,520.00 | 1.53 | 否 |
| 18 | 100050 | 富国全球债券(QDII) | 契约型开放式 | 465,087.39 | 605,683.31 | 1.19 | 否 |
| 19 | 011066 | 大成高新技术产业股票 C | 契约型开放式 | 140,902.86 | 571,051.11 | 1.12 | 是 |
| 20 | 018008 | 大成优选混合(LOF)C | 上市契约型开放式(LOF) | 139,530.37 | 497,565.30 | 0.97 | 是 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------------------------|-------------------------------|------------|------------|------|---|
| 21 | 090007 | 大成策略 回报混合 | 契约 型开 放式 | 403,262.84 | 454,557.87 | 0.89 | 是 |
| 22 | 159985 | 豆粕 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 200,000.00 | 436,400.00 | 0.85 | 否 |
| 23 | 011584 | 大成港股 精选混合 (QDII)C | 契约 型开 放式 | 491,669.41 | 383,600.47 | 0.75 | 是 |
| 24 | 563000 | 易方达 MSCI 中国 A50 互联 互通 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 500,000.00 | 373,500.00 | 0.73 | 否 |
| 25 | 162719 | 广发石油 | 上市 契约 型开 放式 (LOF) | 150,000.00 | 367,020.00 | 0.72 | 否 |
| 26 | 513290 | 汇添富纳 斯达克生 物科技 ETF(QDII) | 交易 型开 放式 (ETF) | 300,000.00 | 365,400.00 | 0.71 | 否 |
| 27 | 011068 | 华宝资源 优选混合 C | 契约 型开 放式 | 104,934.56 | 358,351.52 | 0.70 | 否 |
| 28 | 159980 | 有色 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 200,000.00 | 348,000.00 | 0.68 | 是 |
| 29 | 004317 | 前海开源 沪港深裕 鑫混合 C | 契约 型开 放式 | 279,189.07 | 343,067.53 | 0.67 | 否 |
| 30 | 007574 | 宝盈新价 值混合 C | 契约 型开 放式 | 118,473.67 | 341,441.12 | 0.67 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|------------------|----------------|------------|------------|------|---|
| 31 | 014109 | 融通内需驱动混合 C | 契约型开放式 | 122,936.06 | 341,024.63 | 0.67 | 否 |
| 32 | 017773 | 大成消费主题混合 C | 契约型开放式 | 170,106.40 | 293,161.37 | 0.57 | 是 |
| 33 | 018454 | 大成互联网思维混合 C | 契约型开放式 | 176,056.19 | 267,675.83 | 0.52 | 是 |
| 34 | 016563 | 金鹰红利价值混合 C | 契约型开放式 | 156,110.35 | 256,536.14 | 0.50 | 否 |
| 35 | 016062 | 大成多策略混合 (LOF) C | 上市契约型开放式 (LOF) | 207,358.49 | 250,530.53 | 0.49 | 是 |
| 36 | 110009 | 易方达价值精选混合 | 契约型开放式 | 175,697.28 | 190,368.00 | 0.37 | 否 |
| 37 | 019206 | 大成产业升级股票 (LOF) C | 上市契约型开放式 (LOF) | 67,567.57 | 183,662.17 | 0.36 | 是 |
| 38 | 019183 | 大成精选增值混合 C | 契约型开放式 | 115,115.62 | 181,318.61 | 0.35 | 是 |
| 39 | 159606 | 500 成长 | 交易型开放式 (ETF) | 200,000.00 | 162,400.00 | 0.32 | 否 |
| 40 | 015389 | 宝盈转型动力混合 C | 契约型开放式 | 156,441.94 | 159,664.64 | 0.31 | 否 |
| 41 | 517180 | 南方富时 | 交易 | 100,000.00 | 159,200.00 | 0.31 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------------|-------------------------|------------|------------|------|---|
| | | 中国国企 开放共赢 ETF | 型开 放式 (ETF) | | | | |
| 42 | 159732 | 消费电子 | 交易 型开 放式 (ETF) | 200,000.00 | 134,400.00 | 0.26 | 否 |
| 43 | 019197 | 大成国企 改革灵活 配置混合 C | 契约 型开 放式 | 40,599.80 | 133,167.34 | 0.26 | 是 |
| 44 | 512660 | 国泰中证 军工 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 150,000.00 | 131,850.00 | 0.26 | 否 |
| 45 | 159611 | 电力 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 100,000.00 | 104,400.00 | 0.20 | 否 |
| 46 | 000965 | 汇丰晋信 新动力混 合 | 契约 型开 放式 | 66,789.68 | 97,392.71 | 0.19 | 否 |
| 47 | 010372 | 大成成长 进取混合 C | 契约 型开 放式 | 111,457.87 | 95,920.64 | 0.19 | 是 |
| 48 | 159619 | 基建 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 100,000.00 | 92,300.00 | 0.18 | 否 |
| 49 | 007950 | 招商量化 精选股票 C | 契约 型开 放式 | 44,163.75 | 91,326.22 | 0.18 | 否 |
| 50 | 017821 | 招商优势 企业混合 C | 契约 型开 放式 | 27,033.60 | 91,157.30 | 0.18 | 否 |
| 51 | 513310 | 华泰柏瑞 | 交易 | 60,000.00 | 81,060.00 | 0.16 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------------------|-------------------------------|------------|-----------|------|---|
| | | 中韩芯片 ETF(QDII) | 型开 放式 (ETF) | | | | |
| 52 | 513330 | 华夏恒生 互联网科 技业 ETF(QDII) | 交易 型开 放式 (ETF) | 200,000.00 | 72,000.00 | 0.14 | 否 |
| 53 | 516910 | 富国中证 现代物流 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 50,000.00 | 48,500.00 | 0.09 | 否 |
| 54 | 161226 | 白银基金 | 上市 契约 型开 放式 (LOF) | 50,000.00 | 47,205.00 | 0.09 | 否 |
| 55 | 159615 | 生科 ETF | 交易 型开 放式 (ETF) | 50,000.00 | 29,700.00 | 0.06 | 否 |
| 56 | 000724 | 大成添利 宝货币 A | 契约 型开 放式 | 499.81 | 499.81 | 0.00 | 是 |

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|----|----|----|

| | | |
|---|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 11,507.79 |
| 2 | 应收清算款 | 1,135,200.00 |
| 3 | 应收股利 | 0.06 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 7,501,190.73 |
| 6 | 其他应收款 | 1,471.55 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,649,370.13 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1 | 110076 | 华海转债 | 162,903.49 | 0.32 |
| 2 | 118034 | 晶能转债 | 146,434.68 | 0.29 |
| 3 | 127041 | 弘亚转债 | 115,205.89 | 0.23 |
| 4 | 110082 | 宏发转债 | 111,719.18 | 0.22 |
| 5 | 123113 | 仙乐转债 | 110,000.00 | 0.22 |
| 6 | 127056 | 中特转债 | 109,338.55 | 0.21 |
| 7 | 110073 | 国投转债 | 108,239.67 | 0.21 |
| 8 | 127083 | 山路转债 | 106,796.79 | 0.21 |
| 9 | 113633 | 科沃转债 | 106,746.85 | 0.21 |
| 10 | 123108 | 乐普转 2 | 106,245.75 | 0.21 |
| 11 | 123168 | 惠云转债 | 105,879.32 | 0.21 |
| 12 | 113641 | 华友转债 | 101,467.01 | 0.20 |
| 13 | 111003 | 聚合转债 | 60,217.12 | 0.12 |
| 14 | 127070 | 大中转债 | 58,949.25 | 0.12 |
| 15 | 128136 | 立讯转债 | 57,099.52 | 0.11 |
| 16 | 128135 | 洽洽转债 | 56,762.53 | 0.11 |
| 17 | 113652 | 伟 22 转债 | 56,555.79 | 0.11 |
| 18 | 127031 | 洋丰转债 | 56,251.10 | 0.11 |
| 19 | 110089 | 兴发转债 | 56,189.52 | 0.11 |
| 20 | 127026 | 超声转债 | 55,906.99 | 0.11 |
| 21 | 118024 | 冠宇转债 | 54,826.99 | 0.11 |
| 22 | 113627 | 太平转债 | 54,004.66 | 0.11 |
| 23 | 113584 | 家悦转债 | 53,101.29 | 0.10 |
| 24 | 110081 | 闻泰转债 | 49,551.12 | 0.10 |

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---------------------------|----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 637 | 81,475.12 | 24,176,216.77 | 46.58 | 27,723,436.61 | 53.42 |
| 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y | 148 | 3,086.98 | - | - | 456,873.43 | 100.00 |
| 合计 | 785 | 66,696.21 | 24,176,216.77 | 46.18 | 28,180,310.04 | 53.82 |

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|---------------------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 294,687.24 | 0.5678 |
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y | 12,455.32 | 2.7262 |
| | 合计 | 307,142.56 | 0.5866 |

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|----|------|-------------------|
|----|------|-------------------|

| | | |
|--------------------------------|---------------------------|-------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 0~10 |
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 10~50 |
| | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y | 0~10 |
| | 合计 | 10~50 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 24,176,216.77 | 46.18 | 10,000,138.90 | 19.10 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 10,000.13 | 0.02 | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 297,142.43 | 0.57 | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 24,483,359.33 | 46.76 | 10,000,138.90 | 19.10 | 3年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 大成颐享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 基金合同生效日（2022年8月30日）基金份额总额 | 58,421,506.29 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 53,936,309.46 | - |
| 本报告期基金总申 | 11,329,202.98 | 456,873.43 |

| | | |
|---------------|---------------|------------|
| 购份额 | | |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,365,859.06 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 51,899,653.38 | 456,873.43 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

无。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |

注：本基金采用托管人结算模式，本基金管理人负责选择证券经纪商，租用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用交易单元的使用流程为：首先根据证券经纪商选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行本基金交易单元选择。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|---------------|------------------|--------------|--------------------|------|------------------|---------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 广 | 16,878,761.44 | 61.72 | 7,900,000.00 | 100.00 | - | - | 30,535,199.80 | 67.62 |

| | | | | | | | | | |
|------------------|---------------|-------|---|---|---|---|---------------|-------|--|
| 发 证 券 | | | | | | | | | |
| 申 万 宏 源 | 10,468,808.03 | 38.28 | - | - | - | - | 14,620,457.88 | 32.38 | |

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------------------|------------|
| 1 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（A类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月28日 |
| 2 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（Y类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月28日 |
| 3 | 大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月28日 |
| 4 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月13日 |
| 5 | 大成基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年6月12日 |
| 6 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月23日 |
| 7 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月21日 |
| 8 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）更新招募说明书 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月20日 |
| 9 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（Y类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月18日 |
| 10 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（A类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月18日 |
| 11 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）变更基金经理公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024年5月17日 |
| 12 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加部分代销机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本 | 2024年5月14日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| | | 公司网站 | |
| 13 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 14 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 4 月 17 日 |
| 15 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）Y 类份额增加国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 4 月 15 日 |
| 16 | 大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 4 月 15 日 |
| 17 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 4 月 2 日 |
| 18 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 19 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 1 月 23 日 |
| 20 | 大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2024 年 1 月 19 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------|---------------|---------------|------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20240101-20240630 | 12,671,070.84 | 11,505,145.93 | - | 24,176,216.77 | 46.18 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的文件；
- 2、《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《大成颐享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日